

Probabilidades y Estadística (M)
Práctica 8 (2° cuatrimestre 2003)
Convergencia en Distribución y Teorema Central del Límite

1. Hallar la función característica de X cuando X tiene distribución:

- (a) $\mathcal{P}(\lambda)$
- (b) $\mathcal{Bi}(n, p)$
- (c) $\varepsilon(\lambda)$

2. Probar usando funciones características que si X e Y son independientes entonces

- (a) $X \sim \mathcal{P}(\lambda_1), Y \sim \mathcal{P}(\lambda_2) \Rightarrow X + Y \sim \mathcal{P}(\lambda_1 + \lambda_2)$
- (b) $X \sim \mathcal{Bi}(n, p), Y \sim \mathcal{Bi}(m, p) \Rightarrow X + Y \sim \mathcal{Bi}(n + m, p)$
- (c) Hallar la función característica de $\Gamma(n, \lambda)$ para $n \in \mathbb{N}$, y de una χ_n^2 .
- (d) Calcular para las variables anteriormente nombradas los primeros cuatro momentos, es decir, las $E(X^k)$ con $k = 1, \dots, 4$.

3. Probar que una v.a. X tiene distribución simétrica respecto a 0 si solo si $\phi_X(t)$ es real para todo $t \in \mathbb{R}$.

4. Mostrar que si $(X_n)_{n \geq 1}$ son independientes y simétricas respecto de 0, entonces $\sum_{j=1}^n a_j X_j$ también tiene distribución simétrica respecto de 0

5. Sean $(X_n)_{n \in \mathbb{N}}$ y X v.a. discretas a valores en $\mathbb{N} \cup \{0\}$. Entonces $X_n \xrightarrow{\mathcal{D}} X$ si y sólo si $\lim_{n \rightarrow \infty} p_n(k) = p(k)$ para todo $k \in \mathbb{N}_0$.

6. .

(a) Usando que

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{\cos(xt)}{1+x^2} dx = \pi e^{-|t|}$$

hallar la función característica de una v.a. Cauchy.

(b) Verificar que $\phi_{2X} = \phi_X^2$ con lo cual ϕ_{X+Y} puede coincidir con $\phi_X \cdot \phi_Y$, aunque X e Y no sean independientes.

(c) Hallar la distribución de $\frac{S_n}{n} = \frac{X_1 + \dots + X_n}{n}$ con X_i i.i.d. Cauchy.

7. .

(a) Sean X e Y v.a. i.i.d. con $E(X) = 0$ y $Var(X) = \sigma^2$, $0 < \sigma^2 < \infty$ y tales que $X + Y$ y $X - Y$ son v.a. independientes.

i. Probar que $\phi_X(t) = [\phi_X(\frac{t}{2})]^3 \phi_X(-\frac{t}{2}) \forall t \in \mathbb{R}$.

- ii. Probar que $\phi_X(t) = \phi_X(-t) \forall t \in \mathbb{R}$, usando el desarrollo de Taylor de orden 2.
- iii. Deducir que $\phi_X(t) = [\phi_X(\frac{t}{2})]^4$.
- iv. A partir del ítem anterior deducir que $X \sim N(0, \sigma^2)$.
- (b) Sean X e Y v.a. i.i.d. tales que $Z = \frac{X+Y}{\sqrt{2}}$ tiene la misma distribución que X y $0 < Var(X) = \sigma^2 < \infty$. Probar que $X \sim N(0, \sigma^2)$.
8. Sean X_1, \dots, X_n variables aleatorias i.i.d. $X_n \sim \mathcal{U}[0, 1]$. Sean $Y_n = \min(X_1, \dots, X_n)$, $Z_n = \max(X_1, \dots, X_n)$, $U_n = nY_n$, $V_n = n(1 - Z_n)$. Probar que:
- (a) $Y_n \xrightarrow{p} 0$, $Z_n \xrightarrow{p} 1$.
- (b) $U_n \xrightarrow{\mathcal{D}} W$, $V_n \xrightarrow{\mathcal{D}} W$ donde $W \sim \varepsilon(1)$.
9. Sea $(X_n)_{n \geq 1}$ variables aleatorias i.i.d. tales que $P(X_n = 1) = P(X_n = -1) = \frac{1}{2}$ y definamos $Y_n = \sum_{k=1}^n \frac{X_k}{2^k}$. Probar que $Y_n \xrightarrow{\mathcal{D}} \mathcal{U}[-1, 1]$.
- Sugerencia:* Usar que $\cos(\theta) = \frac{\sin(2\theta)}{2 \sin(\theta)}$.
10. Sean X_1, \dots, X_{100} v.a. i.i.d. con densidad:
- $$f_X(x) = \frac{2}{x^3} I_{(1, \infty)}(x).$$
- Calcular aproximadamente $P\left(\prod_{i=1}^{100} X_i > e^{55}\right)$.
11. Se arroja una moneda, si sale cara se tira 3 veces un dado, si sale ceca se tira 5 veces. Se repite el juego 30 veces. Calcular aproximadamente la probabilidad de obtener más de 22 ases.
12. Una fábrica de tela tiene una tanda de 30 rollos puestos en venta. Se sabe que los metros de tela de una tercera parte de ellos tienen una distribución $\mathcal{U}[10, 30]$ y el número de metros de tela de los rollos restantes tienen una distribución $\mathcal{U}[20, 30]$. Una tienda compró 30 rollos de tela.
- (a) Calcular la probabilidad de que un rollo elegido al azar contenga más de 20 metros de tela.
- (b) Calcular la probabilidad de que la tienda haya comprado por lo menos 650 metros de tela.
- (c) Calcular cuántos rollos debería comprar la tienda para que la probabilidad de adquirir por lo menos 800 metros de tela sea 0.95.
13. En una tabaquería, la demanda de cajas de habanos es $\mathcal{P}(2)$. Cada mañana el dueño completa su stock de manera de tener 2 cajas. Cada caja le deja una ganancia de \$20. Cuando reúna la suma de \$1200 se va de vacaciones al Sur. No trabaja los domingos y empieza a trabajar el día 10 de noviembre.

- (a) Calcular la probabilidad de que pueda irse de vacaciones el día 22 de diciembre por la mañana.
- (b) Calcular una fecha f_0 tal que la probabilidad que pueda partir en f_0 sea aproximadamente 0.95.
14. Con referencia al **ejercicio 13 de la práctica 7**: Una máquina produce artículos de 3 clases: A, B y C en proporciones 25%, 25% y 50% respectivamente. Las longitudes de los artículos A y B siguen distribuciones $\mathcal{U}[0, 1]$ y $\mathcal{U}[0, 2]$ respectivamente y las longitudes de los artículos C se distribuyen según la densidad $f(x) = \left(-\frac{x}{2} + 1\right) I_{[0,2]}(x)$. Se eligen n artículos al azar de la producción total y se calcula el promedio de sus longitudes.
- (a) Calcular aproximadamente la probabilidad de que el promedio de las longitudes esté comprendido entre $\frac{15}{24}$ y $\frac{19}{24}$ si el tamaño de la muestra es $n = 140$. Comparar con la cota hallada en el ejercicio 13 a) de la práctica 7. ¿Es una cota fina del valor calculado con el Teorema Central del Límite?
- (b) ¿Cuál debe ser el tamaño de la muestra para que la probabilidad de que el promedio de las longitudes esté comprendido entre $\frac{15}{24}$ y $\frac{19}{24}$ sea mayor o igual que 0.90?. Hallarlo usando el TCL y compararlo con el hallado en el ejercicio 13 b) de la práctica 7.
15. Con referencia al **ejercicio 14 de la práctica 7**, rehacerlo usando el TCL y comparar la bondad de las cotas obtenidas con este teorema y con la desigualdad de Chebychev.
- Ej. 14 Práctica 7:** Sea p la probabilidad de que una persona elegida al azar apoye la legalización del consumo de marihuana (p es desconocida). Se toma una muestra de 50 personas elegidas al azar, se les pregunta si apoyan o no la legalización y se estima p a partir de la frecuencia relativa f_r que se define por

$$f_r = \frac{\text{N}^\circ \text{de personas encuestadas que están a favor de la legalización}}{50}$$

Observar que f_r es una variable aleatoria, y p es un número. Cuánto más cerca esté f_r de p , mejor estimador será. Hallar una cota superior para $P(|f_r - p| > 0.1)$ que no dependa de p .

16. Sean $(X_n)_{n \geq 1}$ v.a. tales que $\sqrt{n}(X_n - \mu) \xrightarrow{\mathcal{D}} \mathcal{N}(0, \sigma^2)$ y sea $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ tal que g es derivable, g' es continua en μ , $g'(\mu) \neq 0$.
- (a) Mostrar que
- $$\sqrt{n}[g(X_n) - g(\mu)] \xrightarrow{\mathcal{D}} \mathcal{N}(0, \sigma^2 [g'(\mu)]^2)$$
- (b) ¿Cuál será la distribución de $n[g(X_n) - g(\mu)]$ cuando $n \rightarrow \infty$ si $g'(\mu) = 0$ pero $g''(\mu) \neq 0$?

Sugerencia: Usar el desarrollo de Taylor de la función g del orden adecuado.

17. Sean $(X_n)_{n \geq 1}$ v.a. i.i.d., $X_n \sim \mathcal{U}[0, \theta]$, $\theta > 0$. Probar que

$$\sqrt{n}[\ln(2\bar{X}_n) - \ln(\theta)] \xrightarrow{\mathcal{D}} \mathcal{N}(0, \frac{1}{3})$$

donde $\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i$.

18. Sean $(X_n)_{n \geq 1}$ v.a. i.i.d. tales que $E(X_1) = 0$, $E(X_1^2) = 2$, $E(X_1^4) < \infty$ y $P\left(\sum_{i=1}^n X_i^2 = 0\right) = 0 \forall n$. Hallar el límite en distribución de las siguientes variables aleatorias, aclarando las herramientas teóricas utilizadas en cada caso.

(a) $Y_n = \left(\sqrt{n} \sum_{i=1}^n X_i\right) / \sum_{i=1}^n X_i^2$

(b) $Z_n = \left(\sum_{i=1}^n X_i\right) / \sqrt{\sum_{i=1}^n X_i^2}$

(c) $W_n = n \left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i\right)^2$.

19. Sean $(X_n)_{n \geq 1}$ v.a. i.i.d. $X_n \sim \mathcal{P}(\lambda)$. Hallar la distribución límite de $\sqrt{n}(\bar{X}^2 - \lambda^2)$.